

## 新纪元期货程序化交易——宏利一号系统介绍及统计检验展示

模型品种:

宏利一号模型

说明:

宏利一号模型以趋势追踪为基本理念，力求忽视震荡与调整，并努力降低试错和交易成本。本系列模型属于中、长线模型，隔夜持仓。适用品种较多，但参数差异较大，包括股指、橡胶、螺纹、豆油、PTA 等多个品种。

**欢迎投资者交流策略，提出策略定制化要求**

**新纪元期货研究所**

程序化研究小组

联系电话:

010—84261653

0516—83831179

地址: 江苏徐州市淮海东路

153号新纪元期货大厦

## 宏利一号系统介绍及统计检验展示

### 一、 系统介绍

宏利一号模型以趋势追踪为基本理念，力求忽视震荡与调整，并努力降低试错和交易成本。本系列模型属于中、长线模型，隔夜持仓。适用品种较多，但参数差异较大，包括股指、橡胶、螺纹、豆油、PTA 等多个品种。模型适用于资金相对较大、风险承受能力较强的客户，最好进行多品种组合操作。

以下是宏利一号模型在加权连续合约上的统计检验结果汇总。

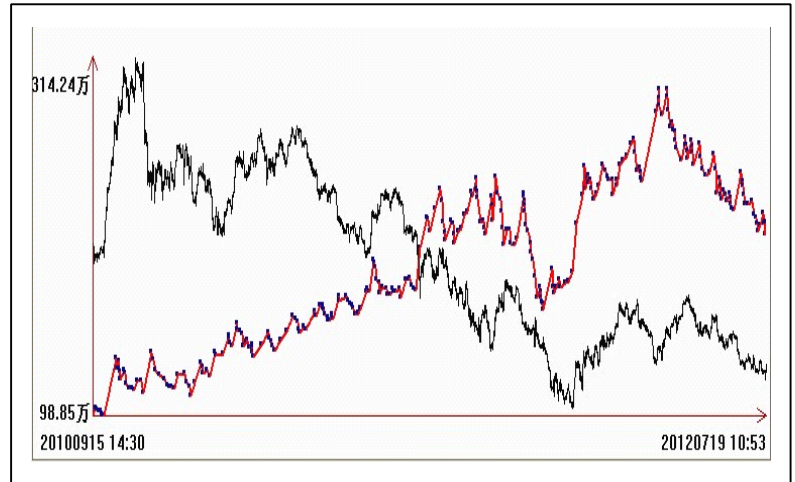
宏利一号（初始资金同为 100 万，仓位为 25%进行的测试）

	盈亏比	胜率 (%)	最大回撤 (%)	测试时间	测试周期	推荐度
股指期货	2.28	36.27%	45%	2010/9/14-2012/7/19	15 分钟	★
螺纹钢	2.55	43.79%	25%	2009/5/14-2012/7/19	30 分钟	★★★
橡胶	3.06	38.71%	50%	2010/5/7-2012/5/7	15 分钟	★
铜	3.21	36.64%	46%	2008/6/5-2012/7/19	30 分钟	★
豆油	3.60	42.36%	18%	2006/3/31-2012/7/19	60 分钟	★★★
白糖	2.54	36.71%	45.5%	2006/3/31-2012/7/19	60 分钟	★
大豆	2.35	40.63%	40%	2006/3/31-2012/7/19	60 分钟	★
豆粕	2.56	41.91%	44%	2006/3/31-2012/7/19	60 分钟	★
棉花	2.77	38.54%	40%	2006/3/31-2012/7/19	60 分钟	★
塑料	2.53	44.11%	30%	2008/6/5-2012/7/19	30 分钟	★★
PTA	2.03	48.77%	35%	2008/6/5-2012/7/19	30 分钟	★★★
锌	2.43	39.69%	45%	2008/6/5-2012/7/19	30 分钟	★

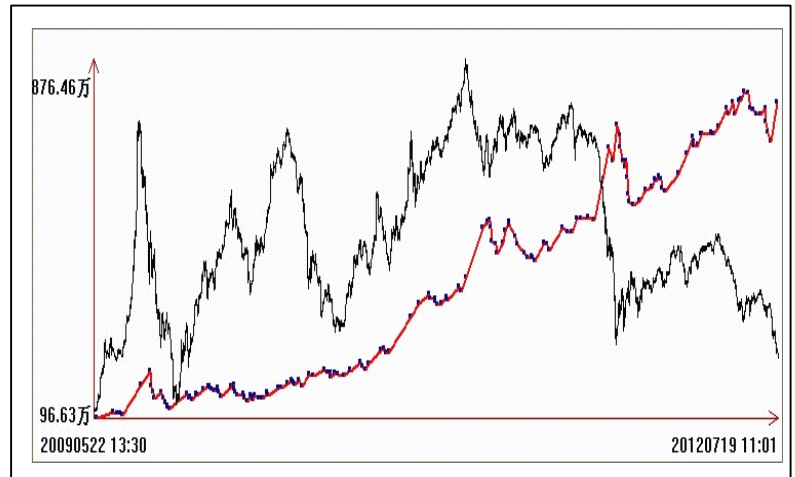
备注：“推荐度”是模型在各品种上的推荐应用程度，★为中性，★★为中度推荐，★★★为优先推荐。

## 二、 统计检验展示

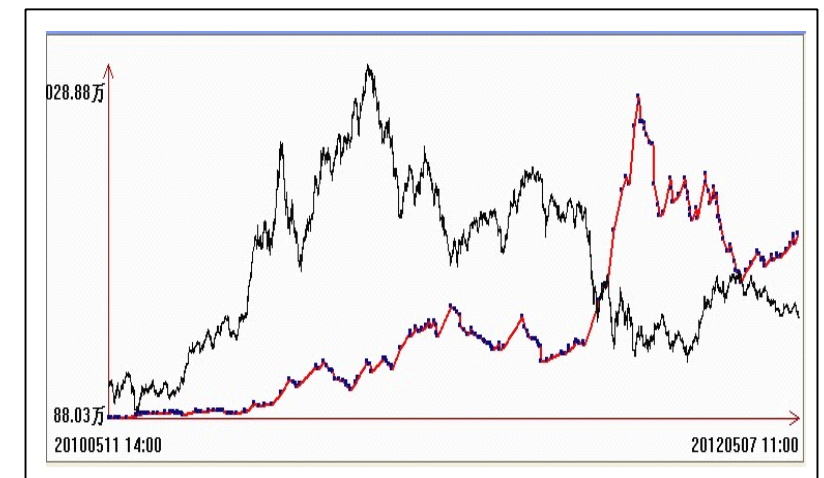
股指期货 15 分钟	
测试日期	2010/9/14-2012/7/19
初始资金	1000000
最终权益	2271089
最大回撤	45%
最大连续亏损次数	11
盈利率	127.11%
胜率	36.27%
平均盈利/平均亏损	5.04%/2.21%
交易次数	284
总手续费/单手手续费	199545/0.06%



螺纹钢 30 分钟	
测试日期	2009/5/14-2012/7/19
初始资金	1000000
最终权益	8522425
最大回撤	25%
最大连续亏损次数	5
盈利率	752.24%
胜率	43.79%
平均盈利/平均亏损	7.87%/3.09%
交易次数	169
总手续费/单手手续费	931740/10

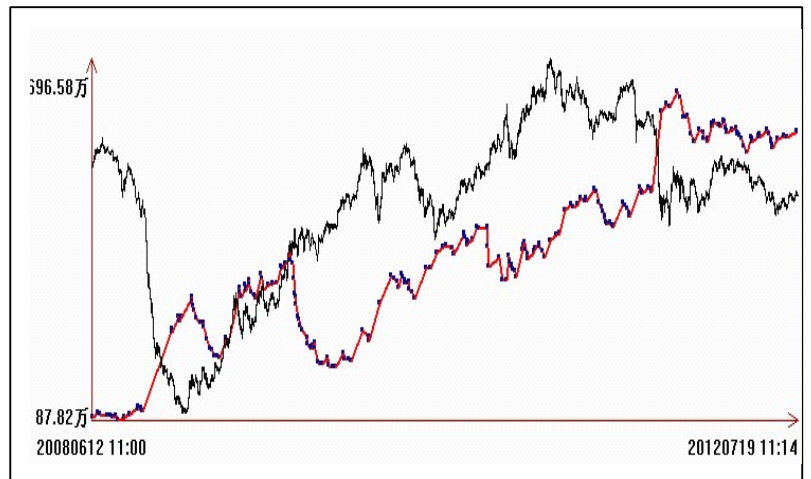


橡胶 15 分钟	
测试日期	2010/5/7-2012/5/7
初始资金	1000000
最终权益	17763648
最大回撤	50%
最大连续亏损次数	8
盈利率	1676.36%
胜率	38.71%
平均盈利/平均亏损	11.11%/3.63%
交易次数	217
总手续费/单手手续费	5459520/60



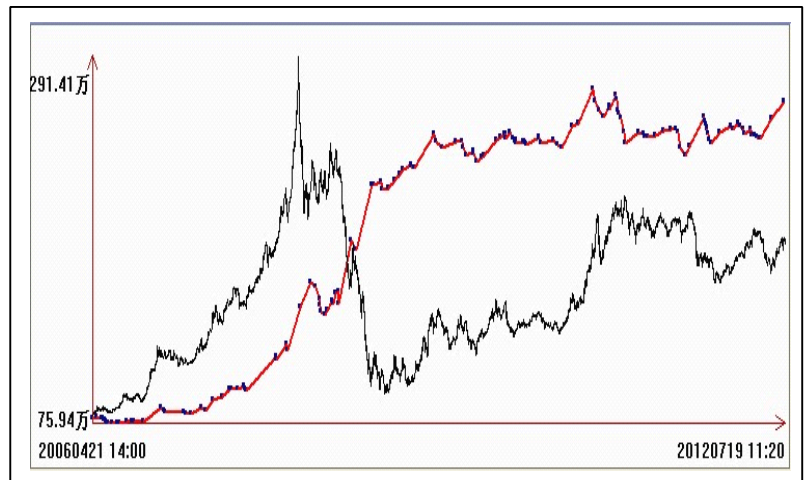
铜 30 分钟

测试日期	2008/6/5-2012/7/19
初始资金	1000000
最终权益	6247954
最大回撤	46%
最大连续亏损次数	10
盈利率	524.80%
胜率	36.64%
平均盈利/平均亏损	7.65%/2.38%
交易次数	232
总手续费/单手手续费	718560/80



豆油 60 分钟

测试日期	2006/3/31-2012/7/19
初始资金	1000000
最终权益	12479845
最大回撤	18%
最大连续亏损次数	9
盈利率	1147.98%
胜率	42.36%
平均盈利/平均亏损	8.47%/2.35%
交易次数	144
总手续费/单手手续费	259400/10



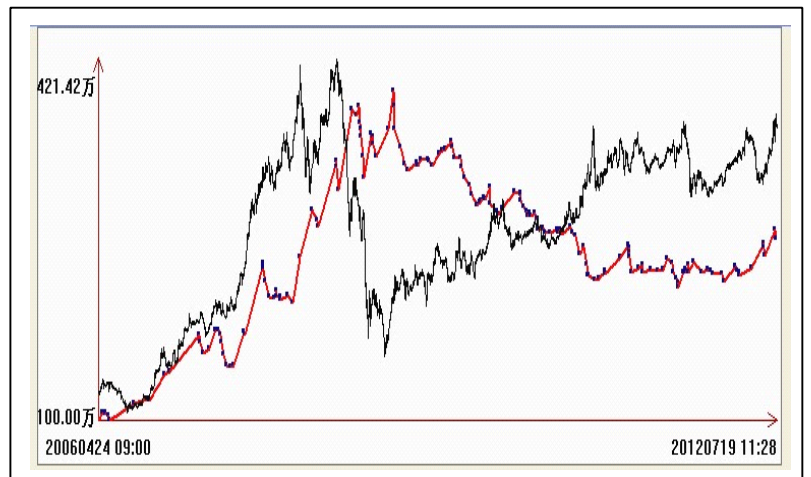
白糖 60 分钟

测试日期	2006/3/31-2012/7/19
初始资金	1000000
最终权益	4226230
最大回撤	45.5%
最大连续亏损次数	8
盈利率	322.62%
胜率	36.71%
平均盈利/平均亏损	8.83%/3.47%
交易次数	237
总手续费/单手手续费	410820/10



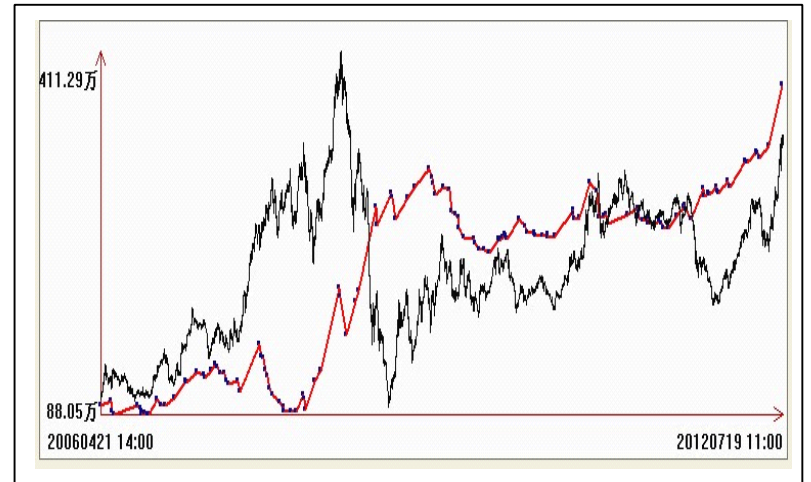
**大豆 60 分钟**

测试日期	2006/3/31-2012/7/19
初始资金	1000000
最终权益	2768300
最大回撤	40%
最大连续亏损次数	6
盈利率	176.83%
胜率	40.63%
平均盈利/平均亏损	5.83%/2.48%
交易次数	160
总手续费/单手手续费	320000/10



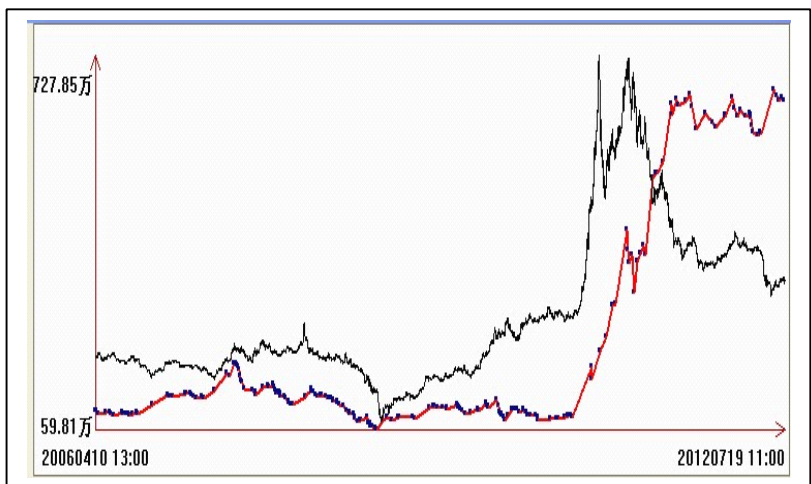
**豆粕 60 分钟**

测试日期	2006/3/31-2012/7/19
初始资金	1000000
最终权益	4112878
最大回撤	44%
最大连续亏损次数	10
盈利率	311.29%
胜率	41.91%
平均盈利/平均亏损	7.84%/3.06%
交易次数	136
总手续费/单手手续费	269960/10



**棉花 60 分钟**

测试日期	2006/3/31-2012/7/19
初始资金	1000000
最终权益	7077013
最大回撤	40%
最大连续亏损次数	13
盈利率	607.70%
胜率	38.54%
平均盈利/平均亏损	9.32%/3.37%
交易次数	205
总手续费/单手手续费	6077012/10





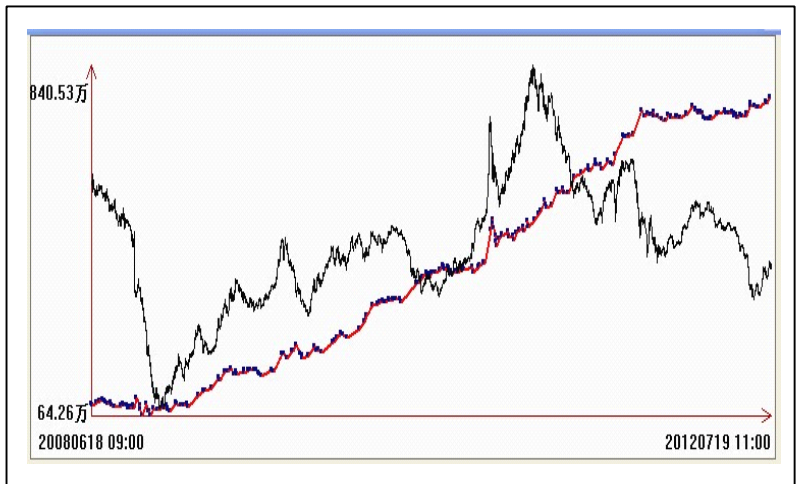
**塑料 30 分钟**

测试日期	2008/6/5-2012/7/19
初始资金	1000000
最终权益	8537803
最大回撤	25%
最大连续亏损次数	9
盈利率	753.78%
胜率	44.11%
平均盈利/平均亏损	4.90%/1.94%
交易次数	263
总手续费/单手续费	7537803/10



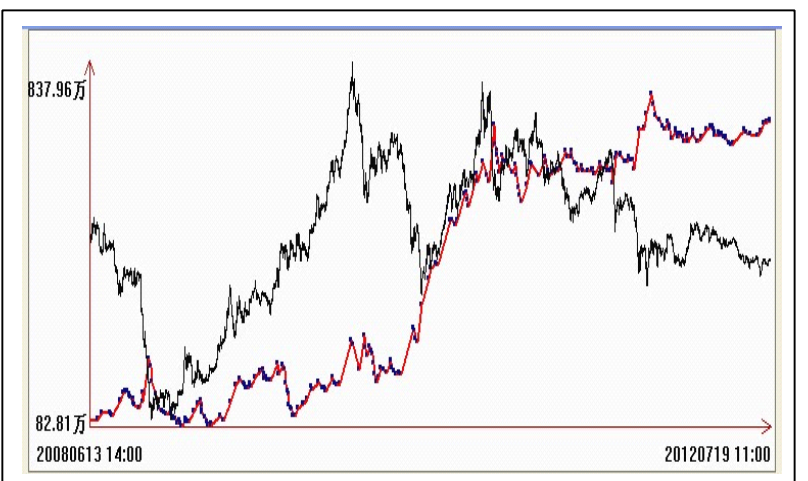
**PTA30 分钟**

测试日期	2008/6/5-2012/7/19
初始资金	1000000
最终权益	8405346
最大回撤	35%
最大连续亏损次数	5
盈利率	740.53%
胜率	48.77%
平均盈利/平均亏损	4.86%/2.39%
交易次数	244
总手续费/单手续费	468340/10



**锌 30 分钟**

测试日期	2008/6/5-2012/7/19
初始资金	1000000
最终权益	7802576
最大回撤	45%
最大连续亏损次数	9
盈利率	680.26%
胜率	39.69%
平均盈利/平均亏损	9.08%/3.74%
交易次数	257
总手续费/单手续费	6802576/15



## 免责声明

本报告的信息来源于已公开的资料，我们力求但不保证这些信息的准确性、完整性或可靠性。报告内容仅供参考，报告中的信息或所表达观点不构成期货交易依据，新纪元期货有限公司不对因使用本报告的内容而引致的损失承担任何责任。投资者不应将本报告为作出投资决策的惟一参考因素，亦不应认为本报告可以取代自己的判断。在决定投资前，如有需要，投资者务必向咨询期货研究员并谨慎决策。

本报告旨在发送给新纪元期货有限公司的特定客户及其他专业人士。报告版权仅为新纪元期货有限公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用发布，需注明出处为新纪元期货有限公司，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

新纪元期货有限公司对于本免责声明条款具有修改权和最终解释权。

## 联系我们

### 新纪元期货总部

地址：江苏省徐州市淮海东路153号新纪元期货大厦

电话：0516-83831105 83831109

### 北京营业部

地址：北京市东城区东四十条 68 号平安发展大厦 407 室

电话：010-84261653

### 南京营业部

地址：南京市北门桥路 10 号 04 栋 3 楼

电话：025-84787997 84787998 84787999

### 广州营业部

地址：广州市越秀区东风东路 703 号粤剧院文化大楼 11 层

电话：020-87750882 87750827 87750826

### 苏州营业部

地址：苏州园区苏华路 2 号国际大厦六层

电话：0512-69560998 69560988

常州营业部

地址：江苏省常州市武进区延政中路 2 号世贸中心 B 栋 2008

电话：0519-88059972 0519-88059978

杭州营业部

地址：浙江省杭州市上城区江城路 889 号香榭商务大厦 7-E、F

电话：0571-56282606 0571-56282608

上海营业部

地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号 1905 室

电话：021-61017393

重庆营业部

地址：重庆市江北区西环路 8 号 B 幢 8-2、8-3、8-3A 号房

电话：023-67900698 023-67109158

**全国统一客服电话：0516-83831105 83831109 欢迎访问我们的网站：<http://www.neweraqh.com.cn>**